



【2023-8-29】

今天人民币兑美元中间价报 7.1851，较上一交易日下调 5 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 5.0/4.75/4.7，2w 成交 5.0，1m 成交 5.35，1y 成交 5.325

FLY 方面（25d），1m 成交 0.1875，9m 成交 0.2875，1y 成交 0.29

Vanilla 方面，2024/3/28 到期 7.4 call 成交在 385~395 价格区间

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
8/29/2023	7.1851	-5
ATM	Traded	Changes
1w 4.0 / 6.0	5.0/4.75/4.7	
2w 4.0 / 6.0	5.0	
1s 4.5 / 6.0	5.35	
2s 4.5 / 5.8		
3s 4.5 / 5.8		
6s 4.8 / 5.5		
9s 4.8 / 5.5		
1y 4.8 / 5.5	5.325	
2y 4.5 / 6.5		
3y 4.5 / 6.5		
25d RR	Traded	changes
1s 0.1 / 0.4		
2s 0.1 / 0.6		
3s 0.2 / 0.6		
6s 0.3 / 0.6		
9s 0.3 / 0.6		
1y 0.3 / 0.6		
25d FLY	Traded	changes
1w 0.15 / 0.3		
1s 0.15 / 0.3	0.1875	
2s 0.15 / 0.3		
3s 0.15 / 0.3		
6s 0.15 / 0.3		
9s 0.15 / 0.3	0.2875	
1y 0.15 / 0.3	0.29	

Daisy Dai

联系人: Rafael Wang
邮箱: rafael.wang@cfets-nex.com.cn

扫描二维码 轻松接收文字版收盘日评及更多资讯



免责声明:

以上所含及附加的所有信息（以下简称“信息”）仅用以提供信息，且为保密的和/或者专用的信息，其知识产权属于上海国际货币经纪有限责任公司（以下简称“上海国际货币”）或第三方，“信息”不能也不应被解释为与任何金融工具、投资或任何交易策略相关的报价、出价、建议或请求。“信息”不可作为决策依据，也不保证其完整性、时效性或准确性等要求，且可未经通知而进行修改。所有陈述和保证均经明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN